

LME 三月到期认沽/看涨期权成交及持仓分析

天富研发制 日期 2006 年 1 月 5 日

日期 NOV05	看跌 期权 成交 量	看涨 期权 成交 量	看跌 期权 持仓 量	看涨 期权 持仓 量	PUT/CALL 量比	Put/Call 持仓比	期权合 约对应 期货价 格	价格 变化	现货价 格	LME 现货/3 个月升贴水	3 个月 期货持 仓量
12.1	0	160	22779	24460	0	93.12%	4526	129	4542	171/181	217045
12.2	74	794	22789	24532	9.31%	92.89%	4548	22	4563	174/184	220379
12.5	97	8	22779	24532	1212%	92.85%	4560	12	4575	178/188	221007
12.6	133	94	22779	24507	141.4%	92.94%	4542	-18	4552	172/177	221303
12.7	1900	240	23179	24507	791%	94.58%	4611	69	4618	165/170	219999
12.8	180	434	8955	8110	41.47%	110.41%	4608	-3	4610	147/152	21847
12.9	600	88	9105	8110	681%	112%	4604	-4	4606	143.5/153.5	214268
12.12	744	370	9305	8090	201%	115%	4504	-100	4374	152/157	218668
12.13	100	8	9305	8090	1250%	115%	4602	98	4603.5	150/155	219440
12.14	120	520	9345	8110	23%	115.2%	4504.5	-97.5	4504.5	147/157	217725
12.15	410	124	9450	8110	330.6%	116.5%	4508	3.5	4508	150/160	217916
12.16	1024	0	9807	8110	DIV	120.92%	4624.5	116.5	4624.5	163.5/173.5	217892
12.19	246	110	9702	8140	223.6%	119.18%	4587	-37.5	4587	162/172	217804
12.20	40	313	9702	8140	12.77%	119.18%	4587	-	4573	158/168	219029
12.21	66	984	9702	8160	6.7%	118.89%	4587	-	4580	160/170	212543
12.22	180	81	9752	8160	222%	119.5%	4587	-	4589.5	154.5/164.5	211186
12.23	42	0	9747	8160	DIV	119.44%	4585.5	0.5	4605.5	146/156	212156
12.28	377	1850	9767	8365	20.3%	116.7%	4622	36.5	4637	149/159	214982
12.29	100	7	9867	8362	1428.5%	117.99%	4584	-38	4594	150/155	216000